

# 华宝 ESG 责任投资混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华宝基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 12 月

## 一、 重要提示

华宝ESG责任投资混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2023】65号文准予注册，自2023年4月28日起正式成立运作。基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华宝ESG责任投资混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，本基金已触发基金合同终止情形，本基金依据法律法规的规定及基金合同的约定履行基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2025年12月2日，并自2025年12月3日起进入清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于2025年12月3日发布的《关于华宝ESG责任投资混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

基金管理人华宝基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、 基金概况

基金名称	华宝 ESG 责任投资混合型证券投资基金
基金简称	华宝 ESG 责任投资混合
基金主代码	018118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 28 日
投资目标	本基金通过精选 ESG 责任投资主题股票，在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。

投资范围	<p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；其中，投资于 ESG 责任投资股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>
投资策略	<p><b>1、大类资产配置策略</b></p> <p>本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。</p> <p><b>2、股票投资策略</b></p> <p>本基金通过将环境、社会和公司治理（ESG）因素纳入投资决策开展责任投资实践，本基金基于内部 ESG 评价体系与第三方 ESG 评级相结合的 ESG 评价数据库，在构建基金风格库时，主要采用负面筛查的投资策略，从政策、行业、公司等不同层面对投资标的进行差异化负面剔除，对于综合 ESG 风险位于后 30% 的投资标的，不纳入风格库，同时，对于符合责任投资标准的公司，深入分析公司基本面和业务前景，判断企业投资价值，有选择性地纳入风格库。对于风格库内公司的 ESG 状况进行持续跟踪和定期评估，以使组合内公司符合 ESG 投资标准，践行责任投资。</p> <p><b>（1）ESG 责任投资主题界定</b></p> <p>本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，深入分析公司的基本面和业务前景，评估企业投资价值。同时结合 ESG 责任投资评价体系，对投资标的进行负面筛选，优选投资标的，构建投资组合。</p> <p>本基金 ESG 责任投资主题界定为，将环境、社会和公司治理（ESG）因素纳入投资决策的投资策略。责任投资是对传统的财务分析和投资组合构建的补</p>

充，有利于解决传统价值投资框架无法解决的企业经营外部性问题。通过践行责任投资，一方面，可以促使上市公司履行社会责任，提升公司核心竞争力，另一方面能够对外传递正向价值，形成良性循环。

对上市公司从责任投资的角度予以评价，需要从国内资本市场特点出发，对公司在环境（E）、社会（S）和公司治理（G）三个方面作出评估。本基金从国内资本市场特点出发，构建投资视角下的本土化ESG评价体系。我们对全球ESG可持续信息披露框架、海外主流ESG评价体系等进行系统的研究。同时，在中国特色与本土化ESG建设方面，我们以国内ESG信息披露框架为基础，结合传统及另类ESG数据为主的企业ESG数据，反映我国资本市场特点，特别是在社会、公司治理维度，设计本土化ESG指标。同时，定期进行ESG评价以及组合ESG风险监测，动态评估投资标的ESG表现。

（2）ESG 责任投资评价体系

1）环境（E）

基金所投上市公司需关注企业活动对气候变化的影响，避免在自然资源保护、能源资源的合理有效利用及废物处理等方面产生环境相关的严重负面争议事件。

主要参考指标包括但不限于：

重点关注指标	主要内容	底层数据点
气候变化风险	公司是否有持续的低碳计划或目标、可持续发展的产品或服务、绿色技术、绿色建筑等	公司是否设定了碳达峰、碳中和目标，阶段性目标减排量分别是多少，完成情况如何；公司是否提供可持续发展的产品或服务，绿色收入占主营业务收入的比重等
自然资源影响及污染废弃物排放风险	公司对于水资源的消耗及依赖程度、可再生能源使用、生物多样性与土地利用、污染的排放与治理等	公司是否建立水资源管理系统，整体对水资源的依赖程度如何；可再生能源在公司能源使用中的比重，是否参与绿电交易；公司生产经营的主要污染及超标排放情况等
环境管理体系与争议事件	公司是否建立了环境管理体系、供应链环境管理体系，过去三年公司是否存在环境违法违规重大处罚等	公司是否建立完善的环境管理体系；公司是否建立供应链环境管理制度，是否定期审查供应商及采购产品碳排放等指标

## 2) 社会责任 (S)

基金所投上市公司需关注公司的人力资本发展、关注员工培养、供应链责任管理、产品安全与质量、捐赠等社会贡献。避免安全事故、安全隐患等负面争议事件可能造成的各种外部性影响。

主要参考的指标包括但不限于：

重点关注指标	主要内容	底层数据点
员工责任与人力资本	公司关注人力资本发展、员工培养计划、员工健康和 safety 等，是否存在严重劳务纠纷等争议事件	公司员工培训人次及时长，员工多元化，员工的薪酬与福利机制是否完善，是否建立完善的健康与安全体系等
客户与供应链责任	公司是否积极保障客户与产品责任、产品安全与质量、金融产品安全、隐私和数据安全，是否存在重大质量事故、隐私数据泄露等争议事件	是否获得国际或者国内的产品质量认证，是否建立完善的产品质量保障机制，是否符合信息安全管理要求，过去三年是否发生严重的产品召回事件，是否设立供应链责任管理体系，通过哪些指标评价供应商社会责任水平等
社会责任与争议事件	公司是否开展社会责任相关的捐赠，是否存在涉及社会维度的负面经营事件等	公司过去一年对外捐赠的金额，是否设立社会责任基金会，过去三年是否发生安全事故等负面经营事件等

## 3) 公司治理 (G)

基金所投上市公司应具备完善的治理结构，关注公司的董事会结构、股权结构、管理层薪酬、商业道德等公司内部治理问题。

主要参考的指标包括但不限于：

重点关注指标	主要内容	底层数据点
ESG 管理体系	公司 ESG 战略及管理体系	公司是否设立 ESG 治理架构，是否设立 ESG 战略及自上而下的 ESG 管理体系

	公司治理架构	控股股东利益是否与公司长期利益保持一致，是否设有员工激励机制。是否存在巨额关联交易、损害中小股东利益等争议事件。信息透明与披露：财务、税收信息是否透明，是否存在虚假信息披露等问题	大股东股权质押水平；公司的所有权结构，是否设有员工激励机制；关联交易金额、关联担保占比等在公司所属类别中的分位数；过去三年是否发生信息披露违规事件，是否涉及相关的处分或处罚等
	公司治理争议事件	是否存在立案调查等公司治理严重争议事件	过去三年是否被证监会、交易所、市场监督管理局、药监局等国家及地方监管部门处罚，是否涉及董监高违规等被立案调查，是否存在董监高失联负面事件等

本基金将根据上述环境（E）、社会（S）和公司治理（G）三个方面的评价指标，通过基于行业建立的 ESG 权重体系，计算公司的 ESG 得分。并根据行业及实际表现，对投资标的划分不同 ESG 风险评级。

ESG 评价基于 ESG 信息披露与舆论监控，进行定期更新与临时调整相结合的评价更新。当相关公司发生重大环境污染、安全事故、公司治理争议事件、财务舞弊等负面事件时，本基金管理人将通过内部研究团队及方法论，对公司的 ESG 评价进行临时调整，以保证相关公司 ESG 评价的及时更新。除内部 ESG 评价体系外，本基金还参考第三方 ESG 评级的评分。

（3）ESG 责任投资评价体系的运用

本基金在 ESG 责任投资评价体系的运用上，主要采用负面筛查策略。本基金对投资标的 ESG 水平、风险事件进行动态监测，并设置环境争议事件、社会负面经营与争议事件、公司治理争议事件等与责任投资（ESG）风险紧密相关的指标。在投资的过程中，构建将内部 ESG 评价体系和外部权威 ESG 评级整合的 ESG 评价数据库，从行业逻辑及个股角度，对不同数据来源的 ESG 评级数据进行归一化和标准化，融合内外部 ESG 评级及风险指标，并根据综合 ESG 数据及 ESG 风险进行排序，最后从政策、行业、公司等不同层面对投资标的进行差异化负面剔除，综合 ESG 风险位于后 30% 的投资标的不纳入基金风格库，同时，深入分析公司基本面和业务前景，判断企业投资价值，构建基金风格库。

同时，本基金将按照国际及国家规范、行业准则或惯例的相关商业标准，对

证券发行人进行筛选，考察企业是否履行劳工、环境、反腐败、反垄断等领域的基本责任，是否遵守行业基本道德要求。对于严重违反国际/国家/行业规范的公司，本基金将剔除出投资选择范围；对于违反情节较轻，并具备改正行为的公司，我们将列入观察名单。

#### （4）港股通股票投资策略

本基金在港股通投资标的的筛选上，注重对基本面良好的股票进行长期投资。股票筛选的方法上，结合公司基本面、相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为等因素，精选符合本基金主题界定的香港上市公司股票。

#### 3、债券投资策略

本基金将投资于债券，以有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。首先，本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合的久期。其次，债券投资组合的构建与调整是一个自下而上的过程，需综合评价个券收益率、波动性、到期期限、票息、赋税条件、流动性、信用等级以及债券持有人结构等决定债券价值的影响因素。同时，本基金将运用系统化的定量分析技术和严格的投资管理制度等方法管理风险，通过久期、平均信用等级、个券集中度等指标，将组合的风险控制在合理的水平。在此基础上，通过各种积极投资策略的实施，追求组合较高的回报。

#### 4、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转换债券的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。

#### 5、股指期货投资策略

本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 7、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货交易。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动

	<p>性、波动水平等指标进行跟踪监控。</p> <p>8、对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>9、融资业务投资策略</p> <p>为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。</p> <p>10、其他金融工具投资策略</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 ESG 基准指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×30%+恒生指数收益率×15%。	
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属基金的基金简称	华宝 ESG 责任投资混合 A	华宝 ESG 责任投资混合 C
下属分级基金的交易代码	018118	018119

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2023】65 号文准予注册，由基金管理人依照法律法规的规定及《基金合同》的约定自 2023 年 4 月 6 日至 2023 年 4 月 26 日止期间向社会公开募集。本基金《基金合同》于 2023 年 4 月 28 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 301,638,512.91 份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为 1,743 户。

根据基金合同“第五部分基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：



“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2025 年 12 月 2 日日终，本基金已出现连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，基金管理人应终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。本基金最后运作日为 2025 年 12 月 2 日，自 2025 年 12 月 3 日起，本基金进入清算程序。

自本基金《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

四、 财务会计报告

华宝ESG责任投资混合型证券投资基金最后运作日资产负债表

单位：人民币元

资产	2025 年 12 月 2 日 (最后运作日)
资产:	
货币资金	18,127,754.93
结算备付金	8,363.38
存出保证金	15,911.95
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	3,281,916.49
应收股利	-

应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	21,433,946.75
负债和净资产	2025 年 12 月 2 日 (最后运作日)
负债：	
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	8,986.60
应付赎回款	1,606,373.02
应付管理人报酬	37,470.13
应付托管费	6,245.05
应付销售服务费	905.85
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	78,540.43
负债合计	1,738,521.08
净资产：	
实收基金	18,043,596.58
未分配利润	1,651,829.09
净资产合计	19,695,425.67
负债和净资产总计	21,433,946.75

注：报告截止日 2025 年 12 月 2 日（最后运作日），基金份额总额 18,043,596.58 份。A 类基金份额净值人民币 1.0921 元，份额总额 17,068,916.64 份；C 类基金份额净值人民币 1.0819 元，份额总额 974,679.94 份。

## 五、 清算报表编制基础

清算财务报表仅供基金管理人为基金财产清算目的提交中国证券监督管理委员会备案。因此，清算财务报表不适用于其他用途。

### (1) 非持续经营基础

如清算报告“三、基金运作情况”所述，本基金已于2025年12月2日终止运作，并已于2025年12月3日进入清算程序，因此本基金2025年12月2日(最后运作日)的清算财务报表是基于非持续经营的基础编制的。

### (2) 特殊编制基础

清算财务报表只列示本基金于2025年12月2日(最后运作日)的资产负债表以及部分清算财务报表附注，不列示比较数据以及相关财务报表附注。清算财务报表未披露自2025年1月1日至2025年12月2日(最后运作日)止期间的利润表、净资产变动表、金融工具的风险分析及敏感性分析、公允价值、关联方关系及其交易相关内容等。因此，清算财务报表不是一份完整的财务报表，也不包含一份完整财务报表所应披露的所有会计政策及附注。

除上段所述事项外，清算财务报表根据以下重要会计政策中所述的会计政策编制，这些会计政策符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求。

## 六、 重要会计政策

### (1) 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。清算财务报表的实际编制期间为自2025年1月1日至2025年12月2日(最后运作日)止。

### (2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制清算财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

## 七、 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014] 81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016] 127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023] 39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

（a）资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（b）对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股

权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

(d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 八、资产负债表日后事项

本基金于2025年12月3日正式进入清算程序。基金财产清算小组按照本基金合同的规定对本基金进行清算。自本基金最后运作日起，本基金的资产负债按预计可变现金额计价。

自2025年12月3日至2025年12月10日（清算结束日）止的期间（以下简称“该期间”），本基金的资产及负债的具体清算情况如下：

### 1、 资产处置情况

本基金最后运作日货币资金余额为人民币18,127,754.93元，其中本金为人民币18,121,973.17元，应计利息为人民币5,781.76元，该期间货币资金净增加人民币1,514,698.01元，于清算结束日货币资金余额为人民币19,642,452.94元，其中本金为人民币19,635,158.46元，应计利息为人民币7,294.48元。

本基金最后运作日结算备付金余额为人民币8,363.38元，其中本金为人民币8,130.71元，应计利息为人民币232.67元。该期间结算备付金净减少人民币5,140.98元，于清算结束日结算备付金余额为人民币3,222.40元，其中本金为人民币2,957.33元，应计利息为人民币265.07元。

本基金最后运作日存出保证金余额为人民币15,911.95元，其中本金为人民币15,904.96元，应计利息为人民币6.99元。该期间存出保证金净减少人民币3,858.97元，于清算结束日存出保证金余额为人民币12,052.98元，其中本金为人民币12,045.11元，应计利息为人民币7.87元。

本基金最后运作日应收清算款余额为人民币3,281,916.49元，已于该期间收回，于清算结束日应收清算款余额为零。

## **2、 负债清偿情况**

本基金最后运作日应付清算款余额为人民币 8,986.60 元，已于该期间支付，于清算结束日应付清算款余额为零。

本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 1,606,373.02 元，已于该期间支付，于清算结束日应付赎回款余额为零。

本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 37,470.13 元，已于该期间支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为零。

本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 6,245.05 元，已于该期间支付，于清算结束日应付托管费余额为零。

本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 905.85 元，已于该期间支付，于清算结束日应付销售服务费余额为零。

本基金最后运作日其他负债余额为人民币 78,540.43 元，已于该期间支付，于清算结束日其他负债余额为零。

3、 清算损益情况

单位：人民币元  
自2025年12月3日  
至2025年12月10日  
止

项目	
一、收益	
1、利息收入（注1）	1,546.62
2、其他收入（注2）	296.44
收益小计	1,843.06
二、费用	
1、其他费用（注3）	-15.73
费用小计	-15.73
三、净损益	1,827.33

注1：利息收入系该期间计提的货币资金、结算备付金及存出保证金利息收入。  
注2：其他收入系该期间的赎回费收入。  
注3：其他费用系该期间的银行汇划手续费和证券组合费。

4、 清算结束日的资产负债及剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2025年12月2日基金净资产	19,695,425.67
加：净损益	1,827.33
减：最后运作日有效赎回申请对应赎回款	39,524.68
二、2025年12月10日基金剩余资产净值	19,657,728.32

资产处置及负债清偿后，截至本次清算结束日 2025 年 12 月 10 日，本基金剩余财产为人民币 19,657,728.32 元。

根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金合同终止日基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

2025 年 12 月 10 日至本基金清算款划出日前一日的货币资金、存出保证金及结算备付

金产生的利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，尚未结息的利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人自有资金垫款产生的利息归属基金管理人所有。

## 九、备查文件

### 1、备查文件目录

- （1）《华宝ESG责任投资混合型证券投资基金清算审计报告》；
- （2）关于《华宝ESG责任投资混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所备投资者查阅。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件。

华宝 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金财产清算小组

2025 年 12 月